

**Fecha de Publicación: 28 de Julio de 2008**  
**Fecha de Información: 24 de Julio de 2008 <sup>1</sup>**

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$968,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9,5%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	118,8	213,0	113,0	98,8	90,0	10,0	321,8
15-35	170,2	396,0	287,5	131,2	75,5	6,0	533,2
36-60	9,3	16,0	16,0	9,3	-	-	25,3
61-90	0,2	3,3	3,3	0,2	-	-	3,5
91-180	1,7	42,8	42,8	1,7	-	-	44,5
>180	40,4	0,2	0,2	40,4	-	-	40,5
<b>Total</b>	<b>340,6</b>	<b>671,2</b>	<b>462,8</b>	<b>281,6</b>	<b>165,5</b>	<b>16,0</b>	<b>968,8</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales)

**Cuadro No. 2**

### Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-3,9 %	11,8 %	16,1 %	13,0 %
15-35	6,6 %	8,4 %	7,9 %	8,1 %
36-60	-	8,7 %	6,9 %	8,0 %
61-90	-	8,1 %	7,4 %	8,1 %
91-180	-	8,7 %	7,7 %	8,6 %
>180	-	9,0 %	7,4 %	7,4 %
<b>Total</b>	<b>4,1 %</b>	<b>9,3 %</b>	<b>10,7 %</b>	<b>9,5 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sector	21 al 25 de Julio				28 de Jul. al 1 de Agosto				4 al 8 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	99	33	2146	2585	66	15	1872	1966	62	20	1277	1466
<b>Otros***</b>	32	99	1646	1606	15	66	1260	1560	20	62	1020	988
<b>Intragrupo</b>	0	0	590	191	0	0	466	72	0	0	258	102
<b>Total</b>	131	131	4382	4382	82	82	3598	3598	82	82	2555	2555

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

\*\*\*Otros agentes sin intragrupo

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es:  $((Tasa\ Pactada/Promedio\ SET\ FX) \wedge (365/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo